

长城双动力股票型证券投资基金

10	600079	人福医药	5,390,660.95	4.68
11	002470	华兰生物	5,225,643.12	4.53
12	600085	悦达投资	4,629,658.00	4.03
13	600199	金种子酒	4,583,349.95	3.96
14	600066	宇通客车	4,329,695.94	3.78
15	600582	天地科技	4,217,908.90	3.66
16	600060	海信电器	3,920,464.01	3.40
17	600048	保利地产	3,745,097.92	3.25
18	000999	华鲁三钢	3,693,689.94	3.21
19	002554	杭钢股份	3,578,187.50	3.10
20	000535	天士力	3,522,311.52	3.06
21	000718	苏宁环球	3,480,356.50	3.02
22	601398	工商银行	3,446,000.00	2.99
23	000028	国药一致	3,241,038.60	2.81
24	600030	中信证券	3,116,489.08	2.70
25	000888	峨边钨业	2,949,902.58	2.56
26	002600	青岛海尔	2,844,542.94	2.47
27	007042	中泰证券	2,661,697.28	2.31
28	002146	荣盛控股	2,479,965.54	2.15
29	300251	光线传媒	2,467,754.50	2.14
30	600999	招商证券	2,441,380.00	2.12

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例
----	------	------	----------	-------------

长城证券有限责任公司(“长城证券”)	基金管理人股东、基金代销机构
东方证券有限责任公司(“东方证券”)	基金管理人股东、基金代销机构
中原信托有限公司	基金管理人股东
北方国际信托股份有限公司	基金管理人股东

注：本基金于2012年度，并无与本基金存在控制关系或其他重大影响关系的关联方发生变化的情况。

以下关联交易均在日常业务范围内发生：

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联交易易单进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2012年1月1日至2012年12月31日	占当期股票成交总额的比例	2011年1月1日至2011年12月31日	占当期股票成交总额的比例
成交金额			成交金额	
长城证券	38,516,146.54	10.32%	135,042,911.82	11.68%

7.4.8.1.2 债券交易

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2012年1月1日至2012年12月31日	占当期债券成交总额的比例	2011年1月1日至2011年12月31日	占当期债券成交总额的比例
成交金额			成交金额	

长城证券	2,930,123.28	100.00%	-	-
7.4.8.1.3 债券回购交易				
注：本基金于本期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。				
7.4.8.1.4 权证交易				
注：本基金于本期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。				
7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金				

金额单位：人民币元

	本期 2012年1月1日至2012年12月31日			
关联方名称	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付 佣金总额的 比例

长城证券	33,488.22	10.47%	2,359.19	3.73%
关联方名称	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付 佣金总额的 比例(%)

长城证券	109,981.35	114.42%	5,843.87	5.13%
------	------------	---------	----------	-------

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除券商需承担的费用（包括但不限于买（卖）经手费、证券结算风险基金上海证券交易所买（卖）证管费等）。

管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

2.4.2 关联方报酬

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
业盟基金之基金管理人		

当期发生的基金应支付的管理费	1,739,011.84	2,271,380.19
其中:支付销售机构的客户维护费	326,630.00	538,418.29

注:基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%的年费率计提。计算方法如下:  

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应支付的基础管理费  
E为前一日的基金资产净值  
基金管理人的管理费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付,由基金托管人于次月前三个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

**7.4.8.2.2 基金托管费**

单位:人民币元

	本期	

项目	2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	289,835.33	378,563.46

注：基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：

基金托管费每日计算, 逐日累计至每月月底, 按月支付; 由基金托管人复核后于次月前三个工作日内从基金财产中一次性支取。

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月 31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
----	---------------------------------	----------------------------------

基金合同生效日( 2009年1月15日 )持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	13,170,699.28	13,170,699.28
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-

减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	13,170,699.28	13,170,699.28
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	10.24%	9.56%

注:基金管理人本期及上年度可比期间持有本基金份额变动相关的交易费用按基金合同及招募说明书的有关规定计算并支付。

关联方	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
7.4.8.4 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况		
注：除基金管理人之外的其他关联方于本期末及上年度末均未持有本基金份额。		
7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入		

单位：人民币元

名称	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	23,957,358.79	232,755.34	27,831,604.70	206,418.83

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，并按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本期及上年度可预期期间均未在承销期内直接购入关联方承销证券。

注：本基金于 2012 年 12 月 31 日因认购尚未在封闭期内且被认购人取消认购所致。

7.4.9 期末（2012 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金于本期末未持有因认购新发增发证券而流通受限的证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金于本期末未持有暂时停牌的股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购  
注：截至本报告期末2012年12月31日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0.00元，无质押债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购  
注：截至本报告期末2012年12月31日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0.00元，无质押债券。

7.4.10、在协助理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.10 有助于注册会计师对财务报表发表无保留审计意见。截至资产负债表日,本基金无需要说明的其他重要事项。

**§ 8 投资组合报告**

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	92,143,400.35	79.00

	其中:股票	92,143,400.35	79.00
2	固定收益投资	--	--
	其中:债券	--	--
	资产支持证券	--	--
3	金融衍生品投资	--	--
4	买入返售金融资产	--	--
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	--	--

5	银行存款和结算备付金合计	24,050,980.93	20.62
6	其他各项资产	442,265.06	0.38
7	合计	116,636,736.34	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	--------------

A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	4,244,080.00	3.65
C	制造业	72,638,662.35	62.54
C0	食品、饮料	12,516,900.00	10.78
C1	纺织、服装、皮毛	444,950.00	0.38
C2	木材、家具	-	-

C3	纸张、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	4,196,300.00	3.61
C5	电子	4,044,000.00	3.48
C6	金属、非金属	1,899,200.00	1.64
C7	机械、设备、仪表	18,047,022.35	15.54
C8	医药、生物制品	31,490,290.00	27.11
C90	其他制造业	-	-

D	电力、煤气及水的生产和供应业	--	--
E	建筑业	--	--
F	交通运输、仓储业	--	--
G	信息技术业	1,209,748.00	1.04
H	批发和零售贸易	7,292,000.00	6.28
I	金融、保险业	--	--

J	房地产业	1,404,000.00	1.21
K	社会服务业	--	--
L	传播与文化产业	--	--
M	综合类	5,355,000.00	4.61
	合计	92,143,490.35	79.33

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位:人民币元				
序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值 占基金资产净值比例 (%)
1	600062	华润双鹤	391,200	8,880,240.00 7.65
2	000513	丽珠集团	178,000	6,194,400.00 5.33
3	600594	益佰制药	285,000	5,702,850.00 4.91

4	600805	悦达投资	450,000	5,355,000.00	4.61
5	600519	贵州茅台	25,000	5,225,500.00	4.50
6	000568	泸州老窖	130,000	4,602,000.00	3.96
7	002508	老板电器	238,609	4,378,475.15	3.77
8	002470	金正大	290,000	4,196,300.00	3.61
9	600060	海信电器	400,000	4,044,000.00	3.48
10	300005	振欧泰	270,000	3,767,000.00	3.24

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本基金管理人网站（[www.ccfund.com.cn](http://www.ccfund.com.cn)）的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	买入金额	占期初基金资产净值比例
000001	平安银行	1,000,000.00	0.12%
000002	万科A	800,000.00	0.10%
000003	招商银行	600,000.00	0.08%
000004	浦发银行	500,000.00	0.06%
000005	民生银行	400,000.00	0.05%
000006	中信银行	300,000.00	0.04%
000007	工商银行	200,000.00	0.03%
000008	农业银行	100,000.00	0.02%
000009	建设银行	100,000.00	0.02%
000010	交通银行	100,000.00	0.02%
000011	光大银行	100,000.00	0.02%
000012	华夏银行	100,000.00	0.02%
000013	兴业银行	100,000.00	0.02%
000014	广发银行	100,000.00	0.02%
000015	中信证券	100,000.00	0.02%
000016	华泰证券	100,000.00	0.02%
000017	招商证券	100,000.00	0.02%
000018	国信证券	100,000.00	0.02%
000019	东方证券	100,000.00	0.02%
000020	安信证券	100,000.00	0.02%
000021	长江证券	100,000.00	0.02%
000022	华泰联合	100,000.00	0.02%
000023	齐鲁证券	100,000.00	0.02%
000024	国元证券	100,000.00	0.02%
000025	宏源证券	100,000.00	0.02%
000026	方正证券	100,000.00	0.02%
000027	浙商证券	100,000.00	0.02%
000028	东吴证券	100,000.00	0.02%
000029	信达证券	100,000.00	0.02%
000030	光大证券	100,000.00	0.02%
000031	华融证券	100,000.00	0.02%
000032	渤海证券	100,000.00	0.02%
000033	山西证券	100,000.00	0.02%
000034	西藏证券	100,000.00	0.02%
000035	川财证券	100,000.00	0.02%
000036	西南证券	100,000.00	0.02%
000037	上海证券	100,000.00	0.02%
000038	江苏证券	100,000.00	0.02%
000039	浙江证券	100,000.00	0.02%
000040	福建证券	100,000.00	0.02%
000041	江西证券	100,000.00	0.02%
000042	山东证券	100,000.00	0.02%
000043	河南证券	100,000.00	0.02%
000044	湖北证券	100,000.00	0.02%
000045	湖南证券	100,000.00	0.02%
000046	广东证券	100,000.00	0.02%
000047	广西证券	100,000.00	0.02%
000048	海南证券	100,000.00	0.02%
000049	重庆证券	100,000.00	0.02%
000050	四川证券	100,000.00	0.02%
000051	贵州证券	100,000.00	0.02%
000052	云南证券	100,000.00	0.02%
000053	陕西证券	100,000.00	0.02%
000054	甘肃证券	100,000.00	0.02%
000055	宁夏证券	100,000.00	0.02%
000056	青海证券	100,000.00	0.02%
000057	新疆证券	100,000.00	0.02%
000058	西藏证券	100,000.00	0.02%
000059	四川证券	100,000.00	0.02%
000060	贵州证券	100,000.00	0.02%
000061	云南证券	100,000.00	0.02%
000062	陕西证券	100,000.00	0.02%
000063	甘肃证券	100,000.00	0.02%
000064	宁夏证券	100,000.00	0.02%
000065	青海证券	100,000.00	0.02%
000066	新疆证券	100,000.00	0.02%
000067	西藏证券	100,000.00	0.02%
000068	四川证券	100,000.00	0.02%
000069	贵州证券	100,000.00	0.02%
000070	云南证券	100,000.00	0.02%
000071	陕西证券	100,000.00	0.02%
000072	甘肃证券	100,000.00	0.02%
000073	宁夏证券	100,000.00	0.02%
000074	青海证券	100,000.00	0.02%

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	(%)
1	002508	老板电器	8,221,511.65	7.13
2	600594	益佰制药	7,675,624.47	6.66
3	600062	华润双鹤	7,651,896.49	6.64
4	000651	格力电器	7,314,220.49	6.35
5	600383	金地集团	7,265,795.14	6.30

6	600835	上海机电	7,212,214.05	6.26
7	000568	泸州老窖	6,183,313.97	5.37
8	002294	信立泰	5,744,843.69	4.98
9	000513	丽珠集团	5,585,772.02	4.85

中信建投	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-

§ 1.2 影响投资者决策的其他重要信息

1. 2012年1月16日, 托管人中国建设银行股份有限公司发布关于董事长任职的公告, 自2012年1月1日起, 王洪章先生就任本行董事长、执行董事。

2. 2012年11月15日, 根据工作需要, 中国建设银行投资托管服务部更名为投资托管业务部。

---